

# 上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2022年7月7日

送出日期：2022年7月8日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。  
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

基金简称	博时上证自然资源 ETF	基金代码	510410
基金管理人	博时基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2012-04-10	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2012-05-11
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日开放申购、赎回
基金经理	王祥	开始担任本基金基金经理的日期	2016-11-02
		证券从业日期	2012-07-01
场内简称	资源 ETF		
扩位简称	资源 ETF		

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

敬请投资者阅读更新的《招募说明书》第十章了解详细情况。

#### 投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

#### 投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。  
为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、新股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。  
在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的90%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

#### 主要投资策略

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具，包括融资融券等。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

#### 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即上证自然资源指数收益率。该指数属于价格指数。

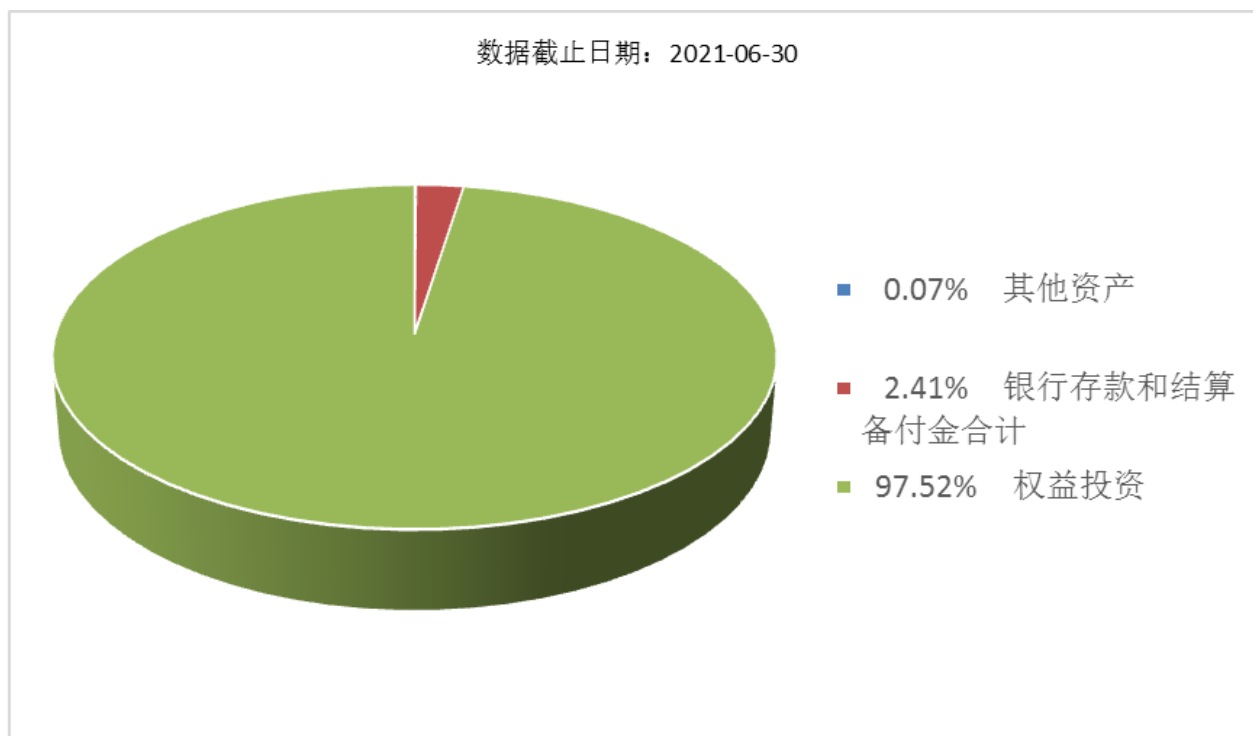
#### 风险收益特征

本基金属于股票型基金，其预期收益及风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高风险、高收益的开放式基金。

本基金为被动式投资的交易型开放式指数证券投资基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证自然资源指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

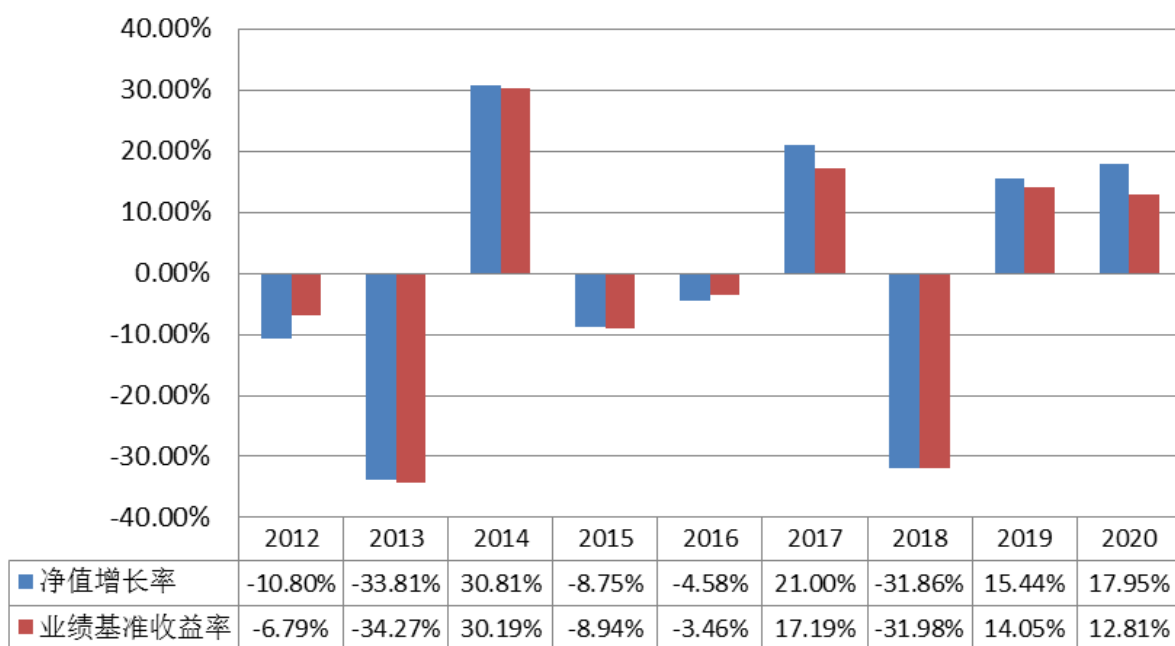
### (二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

#### 投资组合资产配置图表



### (三) 最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

数据截止日期：2020-12-31



注：基金的过往业绩不代表未来表现。

本基金的基金合同于2012年4月10日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 三、投资本基金涉及的费用

#### (一) 基金销售相关费用

场内交易费用以证券公司实际收取为准。

##### 申购费：

投资人在申购基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

##### 赎回费：

投资人在赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

#### (二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	固定比例 0.50%
托管费	固定比例 0.10%
其他费用	基金上市费及年费；基金的指数使用费；基金收益分配发生的费用；基金财产划拨支付的银行费用；基金合同生效后的基金信息披露费用；基金份额持有人大会费用；基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；基金的证券交易费用；证券账户开户费用、银行账户维护费用等

注：本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

### 四、风险揭示与重要提示

#### (一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资者应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件，及时关注本公司出具的适当性意见，各销售机构关于适当性的意见不必然一致，本公司的适当性匹配意见并不表明对基金的风险和收益做出实质性判断或者保证。基金合同中关于基金风险收益特征与基金风险等级因考虑因素不同而存在差异。投资者应了解基金的风险收益情况，结合自身投资目的、期限、投资经验及风险承受能力谨慎决策并自行承担风险，不应采信不符合法律法规要求的销售行为及违规宣传推介材料。

投资于本基金的主要风险包括：

#### 1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

#### 2、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

#### 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于基金投资成本、费用以及指数成份股派发红利、指数成份股调整、基金管理人管理能力等因素，可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率而产生的跟踪偏离风险。

#### 4、标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

#### 5、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，可能存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

#### 6、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

证券交易所在开市后根据申购、赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担。

#### 7、退市风险

因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

#### 8、投资人申购失败的风险

本基金的申购、赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资人在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

#### 9、投资人赎回失败的风险

投资人在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合条件的赎回对价，可能导致赎回失败的情形。

基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位，由此可能导致投资人按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

#### 10、基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

#### 11、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换

基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。因此，投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

#### 12、跟踪误差控制未达约定目标的风险

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### 13、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

(1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

(2) 在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回款项，由此基金管理人可能设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

#### 14、成份股退市的风险

标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份股的退市风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份股替代策略，并对投资组合进行相应调整。

#### 15、投资于存托凭证的风险

16、其他风险：包括流动性风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等。

### (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新。其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

### 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：[www.bosera.com](http://www.bosera.com)][客服电话：95105568]

- (1)基金合同、托管协议、招募说明书
- (2)定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (3)基金份额净值
- (4)基金销售机构及联系方式
- (5)其他重要资料

### 六、其他情况说明

**争议解决方式：**对于因本基金合同产生或与本基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。